

新华中小市值优选股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华中小市值优选股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

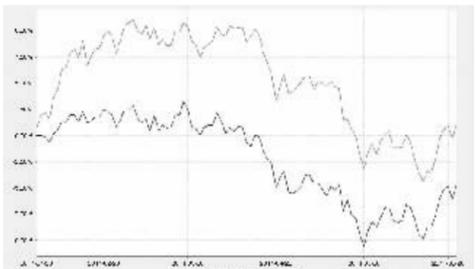
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -149,910.79

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华中小市值优选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
0011年1月28日至2011年6月30日



注:1.本基金自2011年1月28日成立,至2011年6月30日披露日未满一年;2.本基金建仓期为6个月,本报告期,本基金正处于建仓期。

54 管理人报告

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限. Lists 王卫东 as the manager.

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
本报告期,新华基金管理有限公司作为新华中小市值优选股票型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中小市值优选股票型证券投资基金合同》及其他有关法律、法规和基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,基金管理人一直坚持公平交易原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。
4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本报告期内,基金管理人未管理过与本投资组合风格相似的其他基金。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现异常交易行为。

55 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 基金资产配置
5.3 基金行业配置

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选分红混合. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -78,645.69

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选分红混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
0059年9月16日至2011年6月30日

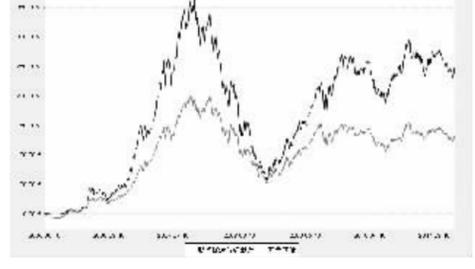


Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, etc.

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔, B.采掘业, C.制造业, etc.

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks like 000789, 000718, etc.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本报告期末,本基金未持有债券。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本报告期末,本基金未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本报告期末,本基金未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末,本基金未持有权证。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 本报告期内,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
5.8.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists 1. 存出保证金 224,406.42, 2. 应收证券清算款 38,655,109.87, etc.

5.8.4 投资组合报告附注的其他重要信息

5.8.4 投资组合报告附注的其他重要信息
5.8.4.1 公平交易专项说明
5.8.4.1.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,基金管理人一直坚持公平交易原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。
5.8.4.1.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本报告期内,基金管理人未管理过与本投资组合风格相似的其他基金。
5.8.4.1.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现异常交易行为。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选分红混合. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
本报告期,新华基金管理有限公司作为新华优选分红混合型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华优选分红混合型证券投资基金合同》及其他有关法律、法规和基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

54 管理人报告

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限. Lists 曹名长 as the manager.

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
本报告期,新华基金管理有限公司作为新华优选分红混合型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华优选分红混合型证券投资基金合同》及其他有关法律、法规和基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 26,077,254.29

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



新华优选成长股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

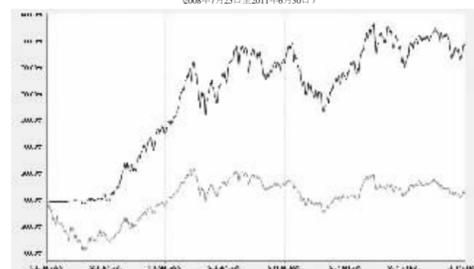
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 26,077,254.29

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



注:本报告期本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

54 管理人报告

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限. Lists 王卫东 as the manager.

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
本报告期,新华基金管理有限公司作为新华优选成长股票型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华优选成长股票型证券投资基金合同》及其他有关法律、法规和基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,基金管理人一直坚持公平交易原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。
4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本报告期内,基金管理人未管理过与本投资组合风格相似的其他基金。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现异常交易行为。

55 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 基金资产配置
5.3 基金行业配置

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 1,248,193,044.73

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 1,248,193,044.73

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



注:本报告期本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

54 管理人报告

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限. Lists 王卫东 as the manager.

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
本报告期,新华基金管理有限公司作为新华优选成长股票型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华优选成长股票型证券投资基金合同》及其他有关法律、法规和基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,基金管理人一直坚持公平交易原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。
4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本报告期内,基金管理人未管理过与本投资组合风格相似的其他基金。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现异常交易行为。

55 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 基金资产配置
5.3 基金行业配置

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

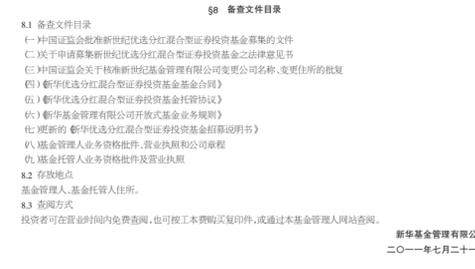
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 1,248,193,044.73

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



新华优选分红混合型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选分红混合. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 476,053,530.14

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选分红混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
0059年9月16日至2011年6月30日



重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

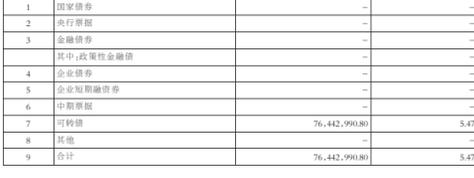
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 1,248,193,044.73

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日



重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,于2011年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称, 新华优选成长股票. Includes details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 1,248,193,044.73

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润总额, etc.

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, etc. Rows include 过去三个月, 3.2.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准的变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较.

新华优选成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年7月25日至2011年6月30日

